

# 汇添富货币市场基金 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2022 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| § 1 重要提示及目录 .....                                  | 2  |
| 1.1 重要提示 .....                                     | 2  |
| 1.2 目录 .....                                       | 3  |
| § 2 基金简介 .....                                     | 5  |
| 2.1 基金基本情况 .....                                   | 5  |
| 2.2 基金产品说明 .....                                   | 6  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 .....                              | 6  |
| 2.4 信息披露方式 .....                                   | 7  |
| 2.5 其他相关资料 .....                                   | 7  |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 .....                            | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                              | 7  |
| 3.2 基金净值表现 .....                                   | 8  |
| § 4 管理人报告 .....                                    | 14 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....                             | 14 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....                   | 19 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                      | 19 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....                  | 19 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....                  | 20 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....                     | 20 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                      | 21 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....            | 21 |
| § 5 托管人报告 .....                                    | 21 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                       | 22 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....      | 22 |
| 5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....            | 22 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....                          | 22 |
| 6.1 资产负债表 .....                                    | 22 |
| 6.2 利润表 .....                                      | 24 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 .....                             | 25 |
| 6.4 报表附注 .....                                     | 27 |
| § 7 投资组合报告 .....                                   | 68 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                               | 68 |
| 7.2 债券回购融资情况 .....                                 | 69 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限 .....                             | 69 |
| 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 .....              | 70 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                         | 70 |
| 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明<br>细 ..... | 70 |
| 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 .....           | 71 |
| 7.8 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证            |    |

|  |    |
|--|----|
| 券投资明细.....                               | 71 |
| 7.9 投资组合报告附注.....                        | 71 |
| § 8 基金份额持有人信息 .....                      | 72 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....               | 72 |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....              | 73 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....            | 73 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....    | 74 |
| § 9 开放式基金份额变动 .....                      | 74 |
| § 10 重大事件揭示 .....                        | 75 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                    | 75 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....    | 75 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....         | 76 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                      | 76 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....               | 76 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....       | 76 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....              | 76 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....               | 78 |
| 10.9 其他重大事件.....                         | 78 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 79 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况..... | 80 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 80 |
| § 12 备查文件目录 .....                        | 80 |
| 12.1 备查文件目录.....                         | 80 |
| 12.2 存放地点 .....                          | 80 |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 80 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|               |                   |         |         |         |         |
|---------------|-------------------|---------|---------|---------|---------|
| 基金名称          | 汇添富货币市场基金         |         |         |         |         |
| 基金简称          | 汇添富货币             |         |         |         |         |
| 基金主代码         | 519518            |         |         |         |         |
| 基金运作方式        | 契约型开放式            |         |         |         |         |
| 基金合同生效日       | 2006 年 03 月 23 日  |         |         |         |         |
| 基金管理人         | 汇添富基金管理股份有限公司     |         |         |         |         |
| 基金托管人         | 上海浦东发展银行股份有限公司    |         |         |         |         |
| 报告期末基金份额总额（份） | 76,736,044,419.43 |         |         |         |         |
| 基金合同存续期       | 不定期               |         |         |         |         |
| 下属分级基金的基金简称   | 汇添富货币 A           | 汇添富货币 B | 汇添富货币 C | 汇添富货币 D | 汇添富货币 E |
| 下属            | 519518            | 519517  | 000642  | 000650  | 012830  |

|                    |                |                   |                |                |                   |
|--------------------|----------------|-------------------|----------------|----------------|-------------------|
| 分级基金的交易代码          |                |                   |                |                |                   |
| 报告期末下属分级基金的份额总额（份） | 362,806,245.75 | 21,741,840,624.75 | 470,437,592.14 | 294,068,398.85 | 53,866,891,557.94 |

## 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 力求本金稳妥和基金资产高流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的投资收益。   |
| 投资策略   | 本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。本基金的投资策略主要包括：滚动配置策略、久期控制策略、套利策略、时机选择策略。 |
| 业绩比较基准 | 税后活期存款利率（即活期存款利率×（1-利息税率））   |
| 风险收益特征 | 本货币市场基金是具有较低风险、中低收益、流动性强的证券投资基金品种。   |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      | 基金管理人                       | 基金托管人              |
|---------|-----------------------------|--------------------|
| 名称      | 汇添富基金管理股份有限公司               | 上海浦东发展银行股份有限公司     |
| 信息披露负责人 | 姓名                          | 李鹏                 |
|         | 联系电话                        | 021-28932888       |
|         | 电子邮箱                        | service@99fund.com |
| 客户服务电话  | 400-888-9918                | 95528              |
| 传真      | 021-28932998                | 021-63602540       |
| 注册地址    | 上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室 | 上海市中山东一路12号        |
| 办公地址    | 上海市黄浦区外马路728号               | 上海市北京东路689号        |
| 邮政编码    | 200010                      | 200001             |
| 法定代表人   | 李文                          | 郑杨                 |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                               |
|---------------------|-------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券时报》                        |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.99fund.com                |
| 基金中期报告备置地点          | 上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                            | 办公地址                              |
|--------|-------------------------------|-----------------------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司, 汇添富基金管理股份有限公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号, 上海市黄浦区外马路 728 号 |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022 年 01 月 01 日 - 2022 年 06 月 30 日) |                |              |              |                |
|---------------|--|----------------|--------------|--------------|----------------|
|               | 汇添富货币 A                                  | 汇添富货币 B        | 汇添富货币 C      | 汇添富货币 D      | 汇添富货币 E        |
| 本期已实现收益       | 3,714,257.08                             | 271,837,466.75 | 4,666,217.47 | 3,154,806.13 | 393,906,203.70 |
| 本期利润          | 3,714,257.08                             | 271,837,466.75 | 4,666,217.47 | 3,154,806.13 | 393,906,203.70 |
| 本期基金净值收益率     | 1.0051%                                  | 1.1257%        | 1.0051%      | 1.0051%      | 1.1257%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 06 月 30 日)                   |                |              |              |                |

|              |                   |                   |                |                |                   |
|--------------|-------------------|-------------------|----------------|----------------|-------------------|
| 期末基金资产净值     | 362,806,245.75    | 21,741,840,624.75 | 470,437,592.14 | 294,068,398.85 | 53,866,891,557.94 |
| 期末基金份额净值     | 1.0000            | 1.0000            | 1.0000         | 1.0000         | 1.0000            |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022年06月30日) |                   |                |                |                   |
| 累计净值收益率      | 61.1376%          | 63.3495%          | 25.8261%       | 25.8256%       | 2.3571%           |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于固定净值型货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、所述基金业绩指标不包含持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本基金 A、B 级别收益分配按月结转份额；C、D、E 级别收益分配按日结转份额。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 汇添富货币 A |          |             |            |               |         |         |
|---------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 阶段      | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④     |
| 过去一个月   | 0.1460%  | 0.0006%     | 0.0292%    | 0.0000%       | 0.1168% | 0.0006% |
| 过去三个月   | 0.4644%  | 0.0006%     | 0.0885%    | 0.0000%       | 0.3759% | 0.0006% |

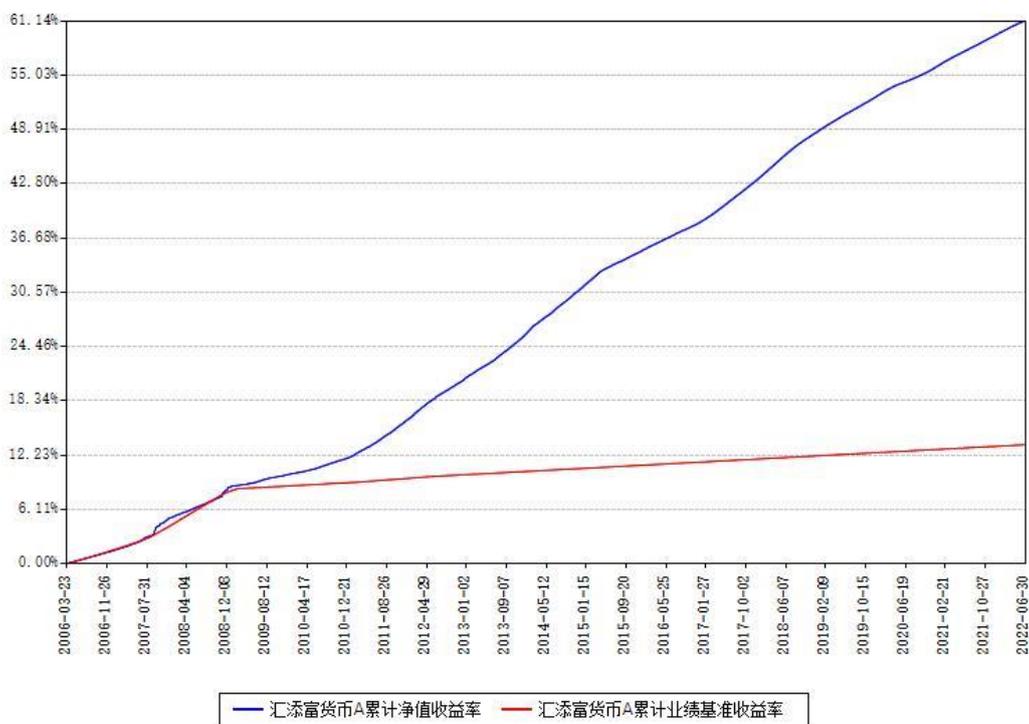
| 过去六个月       | 1.0051%  | 0.0009%     | 0.1760%    | 0.0000%       | 0.8291%  | 0.0009% |
|-------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去一年        | 2.1217%  | 0.0007%     | 0.3549%    | 0.0000%       | 1.7668%  | 0.0007% |
| 过去三年        | 6.8800%  | 0.0009%     | 1.0656%    | 0.0000%       | 5.8144%  | 0.0009% |
| 自基金合同生效日起至今 | 61.1376% | 0.0056%     | 13.3949%   | 0.0029%       | 47.7427% | 0.0027% |
| 汇添富货币 B     |          |             |            |               |          |         |
| 阶段          | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③      | ②—④     |
| 过去一个月       | 0.1658%  | 0.0006%     | 0.0292%    | 0.0000%       | 0.1366%  | 0.0006% |
| 过去三个月       | 0.5245%  | 0.0006%     | 0.0885%    | 0.0000%       | 0.4360%  | 0.0006% |
| 过去六个月       | 1.1257%  | 0.0008%     | 0.1760%    | 0.0000%       | 0.9497%  | 0.0008% |
| 过去一年        | 2.3681%  | 0.0007%     | 0.3549%    | 0.0000%       | 2.0132%  | 0.0007% |
| 过去三年        | 7.6539%  | 0.0009%     | 1.0656%    | 0.0000%       | 6.5883%  | 0.0009% |
| 自基金合同生效日起至今 | 63.3495% | 0.0056%     | 11.0635%   | 0.0028%       | 52.2860% | 0.0028% |
| 汇添富货币 C     |          |             |            |               |          |         |
| 阶段          | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③      | ②—④     |
| 过去一个        | 0.1460%  | 0.0006%     | 0.0292%    | 0.0000%       | 0.1168%  | 0.0006% |

| 月           |          |             |            |               |          |         |
|-------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去三个月       | 0.4644%  | 0.0006%     | 0.0885%    | 0.0000%       | 0.3759%  | 0.0006% |
| 过去六个月       | 1.0051%  | 0.0009%     | 0.1760%    | 0.0000%       | 0.8291%  | 0.0009% |
| 过去一年        | 2.1217%  | 0.0007%     | 0.3549%    | 0.0000%       | 1.7668%  | 0.0007% |
| 过去三年        | 6.8800%  | 0.0009%     | 1.0656%    | 0.0000%       | 5.8144%  | 0.0009% |
| 自基金合同生效日起至今 | 25.8261% | 0.0026%     | 2.8651%    | 0.0000%       | 22.9610% | 0.0026% |
| 汇添富货币 D     |          |             |            |               |          |         |
| 阶段          | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③      | ②-④     |
| 过去一个月       | 0.1460%  | 0.0006%     | 0.0292%    | 0.0000%       | 0.1168%  | 0.0006% |
| 过去三个月       | 0.4644%  | 0.0006%     | 0.0885%    | 0.0000%       | 0.3759%  | 0.0006% |
| 过去六个月       | 1.0051%  | 0.0009%     | 0.1760%    | 0.0000%       | 0.8291%  | 0.0009% |
| 过去一年        | 2.1217%  | 0.0007%     | 0.3549%    | 0.0000%       | 1.7668%  | 0.0007% |
| 过去三年        | 6.8800%  | 0.0009%     | 1.0656%    | 0.0000%       | 5.8144%  | 0.0009% |
| 自基金合同生效日起至今 | 25.8256% | 0.0026%     | 2.8651%    | 0.0000%       | 22.9605% | 0.0026% |
| 汇添富货币 E     |          |             |            |               |          |         |
| 阶段          | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益      | ①-③      | ②-④     |

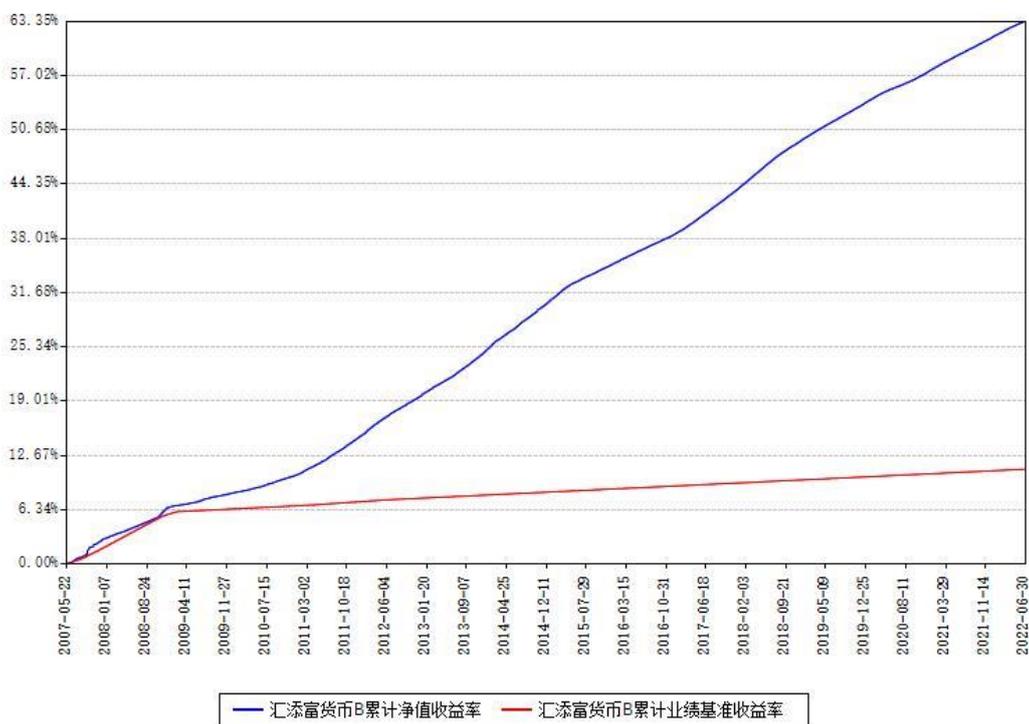
|             |         | 准差②     |         | 率标准差<br>④ |         |         |
|-------------|---------|---------|---------|-----------|---------|---------|
| 过去一个月       | 0.1658% | 0.0006% | 0.0292% | 0.0000%   | 0.1366% | 0.0006% |
| 过去三个月       | 0.5245% | 0.0006% | 0.0885% | 0.0000%   | 0.4360% | 0.0006% |
| 过去六个月       | 1.1257% | 0.0008% | 0.1760% | 0.0000%   | 0.9497% | 0.0008% |
| 自基金合同生效日起至今 | 2.3571% | 0.0007% | 0.3539% | 0.0000%   | 2.0032% | 0.0007% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

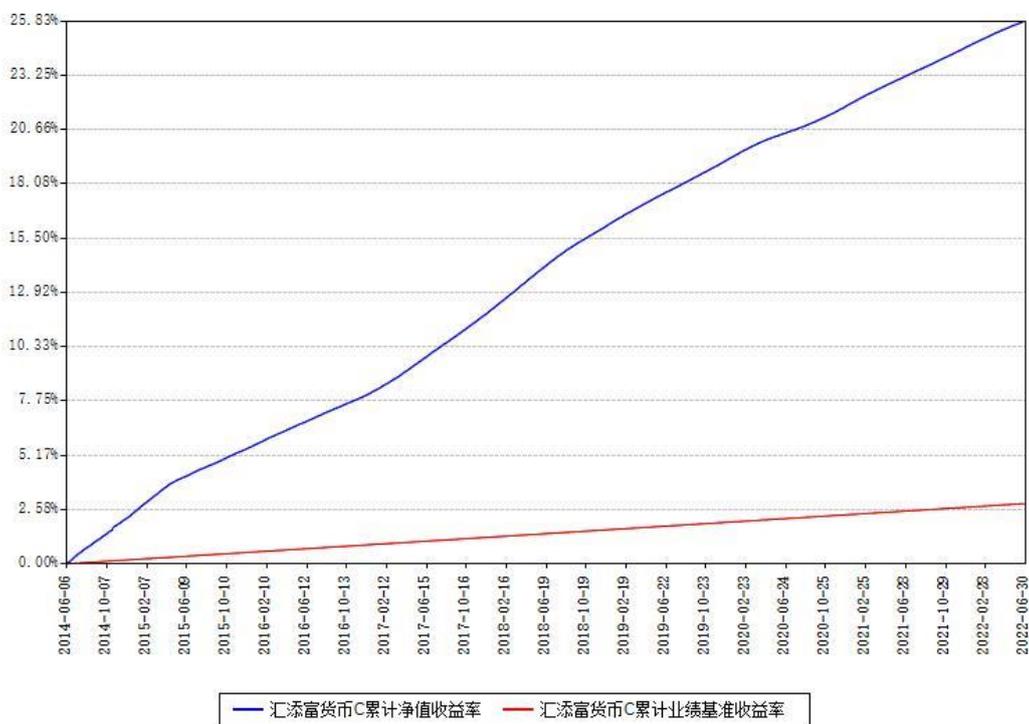
汇添富货币A累计净值收益率与同期业绩基准收益率对比图



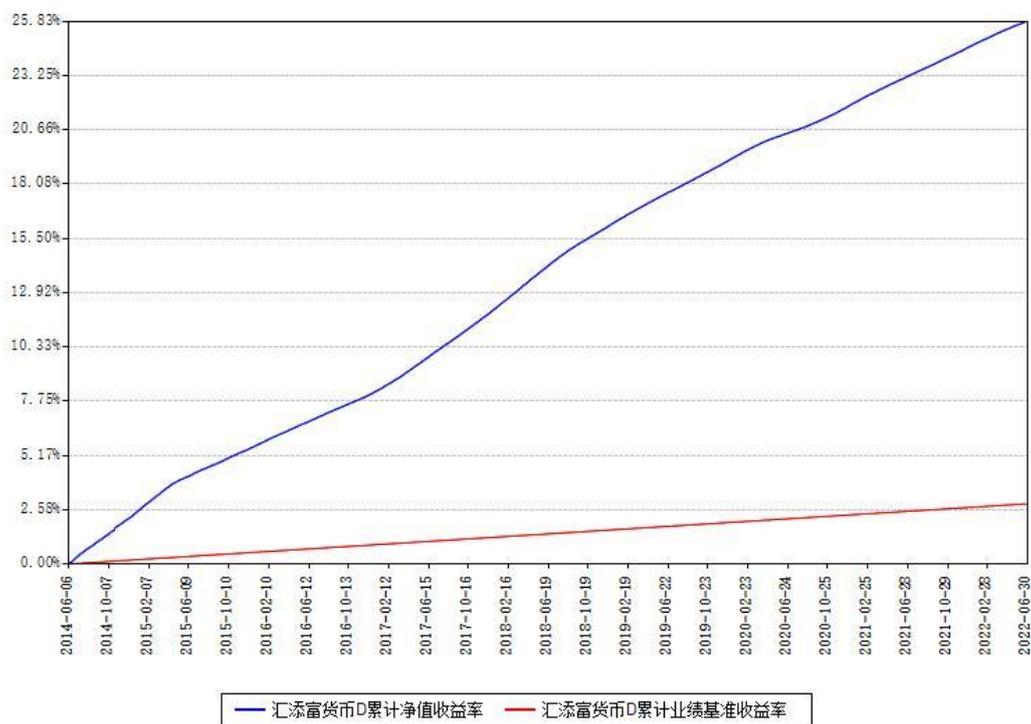
汇添富货币B累计净值收益率与同期业绩基准收益率对比图



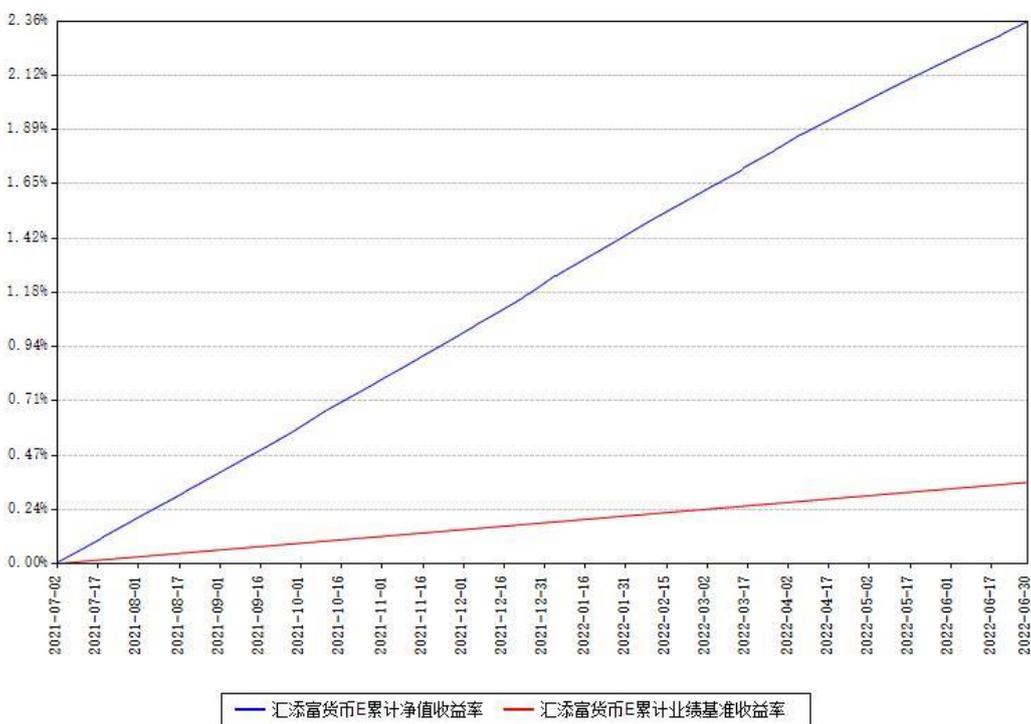
汇添富货币C累计净值收益率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富货币D累计净值收益率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富货币E累计净值收益率与同期业绩基准收益率对比图



注：1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2006年03月23日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

2、本基金于2014年6月5日新增C、D类份额，于2021年7月1日新增E类份额，新增份

额自实际有资产之日起披露业绩数据。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5号文批准，于2005年2月3日正式成立。目前，公司注册资本为132,724,224元人民币。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII基金管理人、RQFII基金管理人、QFII基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富基金自成立以来，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

2022上半年，汇添富基金新成立26只公开募集证券投资基金，包括11只股票型基金、11只混合型基金、4只债券型基金。截至2022年6月30日，公司共管理252只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限（年） | 说明   |
|-----|----------|-----------------|------|-----------|--|
|     |          | 任职日期            | 离任日期 |           |  |
| 温开强 | 本基金的基金经理 | 2019年01月25日     |      | 10        | 国籍：中国。学历：天津大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格，CFA。从业经历：曾任长城基金债券交易员、中金基金交易主管，高级经理。2016年8月加入汇添富基金管理 |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | <p>股份有限公司。<br/>2016 年 8 月 30 日至 2019 年 1 月 25 日任汇添富货币市场基金的基金经理助理。2016 年 8 月 30 日至 2020 年 2 月 26 日任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理助理。2016 年 8 月 30 日至 2022 年 3 月 31 日任汇添富理财 14 天债券型证券投资基金的基金经理助理。2016 年 8 月 30 日至 2019 年 1 月 25 日任汇添富添富通货币市场基金的基金经理助理。2016 年 8 月 30 日至今任汇添富现金宝货币市场基金的基金经理助理。<br/>2016 年 8 月 30 日至 2018 年 8 月 7 日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理助理。2018 年 8 月 7 日至今任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理。<br/>2019 年 1 月 25 日至今任汇添富货币市场基金的基金经理。2019 年 1 月 25 日至 2020 年 10 月 30</p> |
|--|--|--|--|---|

|     |                    |                  |  |    |  |
|-----|--------------------|------------------|--|----|--|
|     |                    |                  |  |    | <p>日任汇添富利率债债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月 25 日至今任汇添富添富通货币市场基金的基金经理。2020 年 2 月 26 日至今任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月 26 日至今任汇添富收益快钱货币市场基金的基金经理。2022 年 3 月 31 日至今任汇添富理财 14 天债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 6 月 10 日至今任汇添富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理。</p> |
| 徐寅喆 | 本基金的基金经理, 现金管理部总经理 | 2018 年 05 月 04 日 |  | 14 | <p>国籍：中国。学历：复旦大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长江养老保险股份有限公司债券交易员。2012 年 5 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任债券交易员、固定收益基金经理助理，现任现金管理部总经理。2014 年 8 月 27</p>   |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>日至 2020 年 10 月 30 日任汇添富利率债债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 8 月 27 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理。</p> <p>2014 年 11 月 26 日至今任汇添富和聚宝货币市场基金的基金经理。2014 年 12 月 23 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富收益快钱货币市场基金的基金经理。2016 年 6 月 7 日至 2018 年 5 月 4 日任汇添富全额宝货币市场基金的基金经理。2018 年 5 月 4 日至今任汇添富货币市场基金的基金经理。</p> <p>2018 年 5 月 4 日至今任汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 5 月 4 日至 2022 年 3 月 31 日任汇添富理财 14 天债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 5 月 4 日至 2020 年 8 月 18 日任汇添富鑫禧债券型证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>2019 年 1 月 25 日至今任汇添富添富通货币市场基金的基金经理。2019 年 9 月 10 日至今任汇添富汇鑫浮动净值型货币市场基金的基金经理。</p> <p>2020 年 2 月 26 日至今任汇添富全额宝货币市场基金的基金经理。2020 年 2 月 26 日至今任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理。2021 年 6 月 24 日至今任汇添富稳利 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 25 日至今任汇添富稳福 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2022 年 5 月 9 日至今任汇添富现金宝货币市场基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|

注:1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期;

2、非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程,以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则,对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块,实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析,具体方法为:在不同时间窗口(日内、3日内、5日内)下,对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易,再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析,进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易,根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上,本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估,严格执行了公平交易制度,公平对待了旗下各投资组合。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 18 次,投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控,事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析,未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年宏观环境发生显著的变化。海外方面,美国通胀高企,美联储连续加息

控制通胀。国内方面，经济当前面临需求收缩、供给冲击和预期转弱的三重压力，短期还有疫情带来的困难，但我国经济呈现出强大的韧性。根据国家统计局的数字，今年上半年 GDP 同比增长 2.5%，其中一季度同比增长 4.8%，二季度增长 0.4%。宏观政策层面，国家陆续出台各项稳增长的措施。货币政策注重发挥总量和结构的双重功能，在发挥总量功能的基础上创新运用结构性货币政策工具，加大稳健的货币政策实施力度。

本报告期内银行间市场流动性充裕，资金利率中枢呈下降趋势，短端债券市场收益率跟随市场流动性波动，但收益率整体走势向下。本基金根据货币政策和宏观经济的变化，投资操作从稳健转向积极，提高组合剩余天数和杠杆水平。资产配置方面，以高等级银行存款、高等级同业存单和交易所逆回购为主。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富货币 A 类份额净值收益率为 1.0051%，同期业绩比较基准收益率为 0.1760%。本报告期汇添富货币 B 类份额净值收益率为 1.1257%，同期业绩比较基准收益率为 0.1760%。本报告期汇添富货币 C 类份额净值收益率为 1.0051%，同期业绩比较基准收益率为 0.1760%。本报告期汇添富货币 D 类份额净值收益率为 1.0051%，同期业绩比较基准收益率为 0.1760%。本报告期汇添富货币 E 类份额净值收益率为 1.1257%，同期业绩比较基准收益率为 0.1760%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年下半年全球经济仍然面临诸多不确定因素。美国和欧洲当前仍处于持续收紧货币政策抗击通胀的阶段，货币政策紧缩必然带来抑制经济和就业增长的负面作用。奥密克戎的变异毒株传播力更强，国内城市仍有可能面临疫情散点复发的风险。房地产方面，坚持“房住不炒”定位，因城施策实施差异化住房信贷政策，促进房地产市场平稳健康发展。宏观政策方面，稳经济一揽子措施正加快落地，财政政策和货币政策持续发力，主要经济指标呈现边际改善，经济恢复势头强劲。

本基金始终坚持货币市场基金作为流动性管理工具的定位，在保障组合流动性安全的情况下，针对宏观环境的变化，研究货币政策的中期导向，努力为基金持有人争取更好的收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，

应参照协会通知执行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部、风险管理及合规稽核人员、基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金 A 级份额和 B 级份额基金收益分配方式为红利再投资，每日进行收益分配；本基金 A 级份额和 B 级份额基金收益为“每日分配、按月支付”。根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每日分配所得收益参与下一日的收益分配，每月集中支付收益。本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资者记正收益；若当日净收益小于零时，为投资者记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资者不记收益。

本基金 A 级份额和 B 级份额每日收益计算并分配时，以人民币元方式簿记，每月累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资者可通过赎回基金份额获得现金收益；本基金 C 级基金份额、D 级基金份额和 E 级基金份额的收益分配为“每日分配，按日支付”。当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一工作日起，不享有基金的分配权益。

本基金期初应付收益为人民币 0.00 元，本报告期内累计分配收益人民币 677,278,951.13 元，均以红利再投资方式结转入实收基金，期末应付收益为人民币 0.00 元。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

## 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对汇添富货币市场基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对汇添富货币市场基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金收益的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由汇添富基金管理股份有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富货币市场基金

报告截止日：2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2022 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                         |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 24,743,140,971.01       | 19,760,569,906.28        |
| 结算备付金      |         | 488,832,533.59          | 572,655,000.00           |
| 存出保证金      |         | -                       | -                        |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 34,059,206,459.42       | 21,506,785,904.86        |
| 其中：股票投资    |         | -                       | -                        |
| 基金投资       |         | -                       | -                        |
| 债券投资       |         | 34,059,206,459.42       | 21,506,785,904.86        |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 资产支持证券投资      |            | -                          | -                           |
| 贵金属投资         |            | -                          | -                           |
| 其他投资          |            | -                          | -                           |
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | 24,915,945,426.07          | 11,860,000,000.00           |
| 债权投资          | 6.4.7.5    | -                          | -                           |
| 其中：债券投资       |            | -                          | -                           |
| 资产支持证券投资      |            | -                          | -                           |
| 其他投资          |            | -                          | -                           |
| 应收清算款         |            | 1,148,986,898.68           | 1,711,780.86                |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | 35,331,519.16              | 380,242.08                  |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.6    | -                          | 142,697,870.27              |
| 资产总计          |            | 85,391,443,807.93          | 53,844,800,704.35           |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2021年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                            |                             |
| 短期借款          |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债       |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | 7,830,615,782.19           | 2,289,946,055.07            |
| 应付清算款         |            | 808,850,483.72             | -                           |
| 应付赎回款         |            | 170,143.41                 | -                           |
| 应付管理人报酬       |            | 9,766,445.42               | 6,238,638.83                |
| 应付托管费         |            | 3,255,481.78               | 2,079,546.26                |
| 应付销售服务费       |            | 874,645.09                 | 689,794.27                  |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |
| 应交税费          |            | 1,468,611.99               | 1,462,671.04                |
| 应付利润          |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                          | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.7    | 397,794.90                 | 690,485.07                  |
| 负债合计          |            | 8,655,399,388.50           | 2,301,107,190.54            |
| <b>净资产：</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.8    | 76,736,044,419.43          | 51,543,693,513.81           |
| 未分配利润         | 6.4.7.9    | -                          | -                           |
| 净资产合计         |            | 76,736,044,419.43          | 51,543,693,513.81           |
| 负债和净资产总计      |            | 85,391,443,807.93          | 53,844,800,704.35           |

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 76,736,044,419.43 份。本基金下属 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 362,806,245.75 份；本基金下属 B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 21,741,840,624.75 份；本基金下属 C 类基金份额净值 1.0000 元，

基金份额总额 470,437,592.14 份;本基金下属 D 类基金份额净值 1.0000 元,基金份额总额 294,068,398.85 份;本基金下属 E 类基金份额净值 1.0000 元,基金份额总额 53,866,891,557.94 份。

比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示:上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年末”余额,上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体:汇添富货币市场基金

本报告期:2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位:人民币元

| 项目                         | 附注号      | 本期<br>2022 年 01 月 01 日<br>至 2022 年 06 月 30<br>日 | 上年度可比期间<br>2021 年 01 月 01 日<br>至 2021 年 06 月 30<br>日 |
|----------------------------|----------|---|--|
| <b>一、营业总收入</b>             |          | <b>757,380,483.72</b>                           | <b>490,962,263.78</b>                                |
| 1. 利息收入                    |          | 428,748,243.48                                  | 489,179,003.81                                       |
| 其中:存款利息收入                  | 6.4.7.10 | 258,234,241.94                                  | 225,693,966.03                                       |
| 债券利息收入                     |          | -   | 175,587,546.17                                       |
| 资产支持证券利息收入                 |          | -   | -  |
| 买入返售金融资产收入                 |          | 170,514,001.54                                  | 87,897,491.61  |
| 证券出借利息收入                   |          | -   | -  |
| 其他利息收入                     |          | -   | -  |
| 2. 投资收益(损失以“-”填列)          |          | 328,571,720.61                                  | 1,639,586.76   |
| 其中:股票投资收益                  | 6.4.7.11 | -   | -  |
| 基金投资收益                     | 6.4.7.12 | -   | -  |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.13 | 328,571,720.61                                  | 1,639,586.76   |
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.14 | -   | -  |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.15 | -   | -  |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.16 | -   | -  |
| 股利收益                       | 6.4.7.17 | -   | -  |
| 以摊余成本计量的金融<br>资产终止确认产生的收益  |          | -   | -  |
| 其他投资收益                     |          | -   | -  |
| 3. 公允价值变动收益(损失以<br>“-”号填列) | 6.4.7.18 | -   | -  |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)         |          | -   | -  |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列)         | 6.4.7.19 | 60,519.63                                       | 143,673.21   |

|                            |            |                       |                       |
|----------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | <b>80,101,532.59</b>  | <b>53,751,418.63</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 45,506,324.31         | 26,118,648.66         |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 15,168,774.74         | 8,706,216.28          |
| 3. 销售服务费                   |            | 4,406,080.63          | 6,833,372.49          |
| 4. 投资顾问费                   |            | -                     | -                     |
| 5. 利息支出                    |            | 14,836,123.83         | 11,905,154.15         |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 14,836,123.83         | 11,905,154.15         |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.20   | -                     | -                     |
| 7. 税金及附加                   |            | 636.53                | 5,387.91              |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.21   | 183,592.55            | 182,639.14            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>677,278,951.13</b> | <b>437,210,845.15</b> |
| 减：所得税费用                    |            | -                     | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | <b>677,278,951.13</b> | <b>437,210,845.15</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | <b>-</b>              | <b>-</b>              |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | <b>677,278,951.13</b> | <b>437,210,845.15</b> |

注：比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富货币市场基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |                |                   |
|----------------------|--|----------------|-------------------|
|                      | 实收基金                                     | 未分配利润          | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产(基金净值)      | 51,543,693,513.81                        | -              | 51,543,693,513.81 |
| 加：会计政策变更             | -  | -              | -                 |
| 二、本期期初净资产(基金净值)      | 51,543,693,513.81                        | -              | 51,543,693,513.81 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 25,192,350,905.62                        | -              | 25,192,350,905.62 |
| （一）、综合收益总额           | -  | 677,278,951.13 | 677,278,951.13    |
| （二）、本期基金             | 25,192,350,905.62                        | -              | 25,192,350,905.62 |

|  |                                    |                 |                    |
|--|------------------------------------|-----------------|--------------------|
| 份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）              |                                    |                 |                    |
| 其中：1. 基金申购款                              | 78,977,524,951.45                  | -               | 78,977,524,951.45  |
| 2. 基金赎回款                                 | -53,785,174,045.83                 | -               | -53,785,174,045.83 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                  | -677,278,951.13 | -677,278,951.13    |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                          | 76,736,044,419.43                  | -               | 76,736,044,419.43  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年06月30日 |                 |                    |
|  | 实收基金                               | 未分配利润           | 净资产合计              |
| 一、上期期末净资产（基金净值）                          | 30,598,430,319.72                  | -               | 30,598,430,319.72  |
| 加：会计政策变更                                 | -                                  | -               | -                  |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 30,598,430,319.72                  | -               | 30,598,430,319.72  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 6,589,800,648.68                   | -               | 6,589,800,648.68   |
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | 437,210,845.15  | 437,210,845.15     |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 6,589,800,648.68                   | -               | 6,589,800,648.68   |
| 其中：1. 基金申购款                              | 63,463,105,842.58                  | -               | 63,463,105,842.58  |
| 2. 基金赎回款                                 | -56,873,305,193.90                 | -               | -56,873,305,193.90 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                  | -437,210,845.15 | -437,210,845.15    |
| 四、本期期末净资产                                | 37,188,230,968.40                  | -               | 37,188,230,968.40  |

|          |  |  |  |
|----------|--|--|--|
| 资产(基金净值) |  |  |  |
|----------|--|--|--|

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|           |           |            |
|-----------|-----------|------------|
| <u>张晖</u> | <u>李骁</u> | <u>雷青松</u> |
| 基金管理人负责人  | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人    |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富货币市场基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2006]21 号文《关于核准汇添富货币市场基金募集的批复》的核准，由汇添富基金管理有限公司（现汇添富基金管理股份有限公司）向社会公开发行募集，基金合同于 2006 年 3 月 23 日正式生效，首次设立募集规模为 4,104,914,022.13 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司和汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

2007 年 5 月 22 日，本基金按照 500 万份基金份额的界限划分为 A 级基金份额和 B 级基金份额，A 级、B 级基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，单一持有人持有 500 万份基金份额以下的为 A 级，达到或超过 500 万份的为 B 级。本基金份额分级规则于分级日起生效。基金分级后，当份额持有人在单个基金账户保留的基金份额减少至 500 万份以下时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 B 级基金份额降级为 A 级基金份额；相应地，当达到或超过 500 万份时，A 级基金份额自动升级为 B 级基金份额。两级基金份额单独计算及公布基金日收益和基金七日收益率。

自 2014 年 6 月 5 日起，本基金增设 C 类和 D 类份额类别，C 类和 D 类基金份额仅开通场外方式办理申购和赎回等业务，C 类基金份额注册登记机构为汇添富基金管理股份有限公司，D 类基金份额注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

自 2021 年 7 月 1 日起，本基金增设 E 类份额类别，E 类基金份额仅开通场外方式办理申购和赎回等业务，基金注册登记机构为汇添富基金管理股份有限公司。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397

天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券,以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金以价值分析为基础,宏观与微观、定性与定量相结合,通过专业的流动性管理为投资者实现资产的保值、增值,力求本金稳妥和基金资产高流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的投资收益。本基金的业绩比较基准为:税后活期存款利率(即活期存款利率 $\times$ (1-利息税率))。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第5号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2022年06月30日的财务状况以及2022年01月01日至2022年06月30日的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外,本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产;

## (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，在初始确认时以公允价值计量；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本

或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会令第 120 号《货币市场基金监督管理办法》的规定，如果出现因提前支取而导致的利息损失的情形，基金管理人应当使用风险准备金予以弥补，风险准备金不足的，应当使用固有资金予以弥补；

(2) 债券投资和资产支持证券投资按实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，在债券投资和资产支持证券投资的实际持有期内逐日计提；处置债券投资和资产支持证券投资的投资收益于成交日确认，并按成交金额与其账面价值的差额入账；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 19,760,569,906.28 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 119,051,021.47 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 19,879,620,927.75 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币

572,655,000.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 283,464.28 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 572,938,464.28 元。

买入返售金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 11,860,000,000.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,725,094.11 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 11,862,725,094.11 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 142,697,870.27 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 119,051,021.47 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 283,464.28 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 20,638,290.41 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 2,725,094.11 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 21,506,785,904.86 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 20,638,290.41 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 21,527,424,195.27 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,289,946,055.07 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 339,195.94 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,290,285,251.01 元。

应付利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 339,195.94 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币 339,195.94 元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 1. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

##### 2. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳

农村教育事业费附加的单位外) 及地方教育费附加。

### 3. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定, 自 2004 年 1 月 1 日起, 对证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金) 管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入, 继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定, 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

### 4. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定, 自 2008 年 10 月 9 日起, 对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

| 项目              | 本期末<br>2022 年 06 月 30 日 |
|-----------------|-------------------------|
| 活期存款            | 3,016,794,924.70        |
| 等于: 本金          | 3,016,233,229.48        |
| 加: 应计利息         | 561,695.22              |
| 定期存款            | 21,726,346,046.31       |
| 等于: 本金          | 21,600,000,000.00       |
| 加: 应计利息         | 126,346,046.31          |
| 其中: 存款期限 1 个月以内 | -                       |
| 存款期限 1-3 个月     | 1,200,841,250.08        |
| 存款期限 3 个月以上     | 20,525,504,796.23       |
| 其他存款            | -                       |
| 等于: 本金          | -                       |
| 加: 应计利息         | -                       |
| 合计              | 24,743,140,971.01       |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

| 项目 | 本期末<br>2022 年 06 月 30 日 |
|----|-------------------------|
|    |                         |

|        |       | 按实际利率<br>计算的账面<br>价值  | 影子定价                  | 偏离金额              | 偏离度 (%) |
|--------|-------|-----------------------|-----------------------|-------------------|---------|
| 债券     | 交易所市场 | -                     | -                     | -                 | -       |
|        | 银行间市场 | 34,059,206,<br>459.42 | 34,072,244,<br>435.63 | 13,037,976.<br>21 | 0.0170  |
|        | 合计    | 34,059,206,<br>459.42 | 34,072,244,<br>435.63 | 13,037,976.<br>21 | 0.0170  |
| 资产支持证券 |       | -                     | -                     | -                 | -       |
| 合计     |       | 34,059,206,<br>459.42 | 34,072,244,<br>435.63 | 13,037,976.<br>21 | 0.0170  |

注：偏离金额=影子定价-按实际利率计算的账面价值；偏离度=偏离金额/通过按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022年06月30日 |           |
|-------|--------------------|-----------|
|       | 账面余额               | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 24,915,945,426.07  | -         |
| 银行间市场 | -                  | -         |
| 合计    | 24,915,945,426.07  | -         |

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内不存在债权投资减值准备计提情况。

### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2022 年 06 月 30 日 |
|--------------|-------------------------|
| 应付券商交易单元保证金  | -                       |
| 应付赎回费        | 611.65                  |
| 应付证券出借违约金    | -                       |
| 应付交易费用       | 203,744.90              |
| 其中：交易所市场     | -                       |
| 银行间市场        | 203,744.90              |
| 应付利息         | -                       |
| 应付审计费        | 124,630.98              |
| 应付信息披露费      | 59,507.37               |
| 应付指数使用费      | -                       |
| 应付账户维护费      | 9,300.00                |
| 应付汇划费        | -                       |
| 应付上市费        | -                       |
| 应付持有人大会费-公证费 | -                       |
| 应付持有人大会费-律师费 | -                       |
| 其他           | -                       |
| 合计           | 397,794.90              |

### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

| 汇添富货币 A       |                                       |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| 项目            | 本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |                 |
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 739,946,875.63                        | 739,946,875.63  |
| 本期申购          | 409,201,354.50                        | 409,201,354.50  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -786,341,984.38                       | -786,341,984.38 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                     | -               |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -               |
| 本期申购          | -                                     | -               |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -               |
| 本期末           | 362,806,245.75                        | 362,806,245.75  |
| 汇添富货币 B       |                                       |                 |

| 项目             | 本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |                    |
|----------------|---------------------------------------|--------------------|
|                | 基金份额 (份)                              | 账面金额               |
| 上年度末           | 27,142,224,562.44                     | 27,142,224,562.44  |
| 本期申购           | 11,454,312,361.84                     | 11,454,312,361.84  |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -16,854,696,299.53                    | -16,854,696,299.53 |
| 基金拆分/份额折算前     | -                                     | -                  |
| 基金拆分/份额折算调整    | -                                     | -                  |
| 本期申购           | -                                     | -                  |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -                                     | -                  |
| 本期末            | 21,741,840,624.75                     | 21,741,840,624.75  |
| 汇添富货币 C        |                                       |                    |
| 项目             | 本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |                    |
|                | 基金份额 (份)                              | 账面金额               |
| 上年度末           | 572,098,262.59                        | 572,098,262.59     |
| 本期申购           | 755,580,406.78                        | 755,580,406.78     |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -857,241,077.23                       | -857,241,077.23    |
| 基金拆分/份额折算前     | -                                     | -                  |
| 基金拆分/份额折算调整    | -                                     | -                  |
| 本期申购           | -                                     | -                  |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -                                     | -                  |
| 本期末            | 470,437,592.14                        | 470,437,592.14     |
| 汇添富货币 D        |                                       |                    |
| 项目             | 本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |                    |
|                | 基金份额 (份)                              | 账面金额               |
| 上年度末           | 324,596,112.29                        | 324,596,112.29     |
| 本期申购           | 47,122,199.71                         | 47,122,199.71      |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -77,649,913.15                        | -77,649,913.15     |
| 基金拆分/份额折算前     | -                                     | -                  |
| 基金拆分/份额折算调整    | -                                     | -                  |
| 本期申购           | -                                     | -                  |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -                                     | -                  |

|                    |                                       |                    |
|--------------------|---------------------------------------|--------------------|
| 本期末                | 294,068,398.85                        | 294,068,398.85     |
| 汇添富货币 E            |                                       |                    |
| 项目                 | 本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |                    |
|                    | 基金份额 (份)                              | 账面金额               |
| 上年度末               | 22,764,827,700.86                     | 22,764,827,700.86  |
| 本期申购               | 66,311,308,628.62                     | 66,311,308,628.62  |
| 本期赎回 (以<br>“-”号填列) | -35,209,244,771.54                    | -35,209,244,771.54 |
| 基金拆分/份额折<br>算前     | -                                     | -                  |
| 基金拆分/份额折<br>算调整    | -                                     | -                  |
| 本期申购               | -                                     | -                  |
| 本期赎回 (以<br>“-”号填列) | -                                     | -                  |
| 本期末                | 53,866,891,557.94                     | 53,866,891,557.94  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

| 汇添富货币 A                |                |       |                |
|------------------------|----------------|-------|----------------|
| 项目                     | 已实现部分          | 未实现部分 | 未分配利润合计        |
| 本期期初                   | -              | -     | -              |
| 本期利润                   | 3,714,257.08   | -     | 3,714,257.08   |
| 本期基金份额<br>交易产生的变<br>动数 | -              | -     | -              |
| 其中：基金申<br>购款           | -              | -     | -              |
| 基金赎回款                  | -              | -     | -              |
| 本期已分配利<br>润            | -3,714,257.08  | -     | -3,714,257.08  |
| 本期末                    | -              | -     | -              |
| 汇添富货币 B                |                |       |                |
| 项目                     | 已实现部分          | 未实现部分 | 未分配利润合计        |
| 本期期初                   | -              | -     | -              |
| 本期利润                   | 271,837,466.75 | -     | 271,837,466.75 |
| 本期基金份额<br>交易产生的变<br>动数 | -              | -     | -              |
| 其中：基金申                 | -              | -     | -              |

|                |                 |       |                 |
|----------------|-----------------|-------|-----------------|
| 购款             |                 |       |                 |
| 基金赎回款          | -               | -     | -               |
| 本期已分配利润        | -271,837,466.75 | -     | -271,837,466.75 |
| 本期末            | -               | -     | -               |
| 汇添富货币 C        |                 |       |                 |
| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分 | 未分配利润合计         |
| 本期期初           | -               | -     | -               |
| 本期利润           | 4,666,217.47    | -     | 4,666,217.47    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -               | -     | -               |
| 其中：基金申购款       | -               | -     | -               |
| 基金赎回款          | -               | -     | -               |
| 本期已分配利润        | -4,666,217.47   | -     | -4,666,217.47   |
| 本期末            | -               | -     | -               |
| 汇添富货币 D        |                 |       |                 |
| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分 | 未分配利润合计         |
| 本期期初           | -               | -     | -               |
| 本期利润           | 3,154,806.13    | -     | 3,154,806.13    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -               | -     | -               |
| 其中：基金申购款       | -               | -     | -               |
| 基金赎回款          | -               | -     | -               |
| 本期已分配利润        | -3,154,806.13   | -     | -3,154,806.13   |
| 本期末            | -               | -     | -               |
| 汇添富货币 E        |                 |       |                 |
| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分 | 未分配利润合计         |
| 本期期初           | -               | -     | -               |
| 本期利润           | 393,906,203.70  | -     | 393,906,203.70  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -               | -     | -               |
| 其中：基金申购款       | -               | -     | -               |
| 基金赎回款          | -               | -     | -               |
| 本期已分配利润        | -393,906,203.70 | -     | -393,906,203.70 |

|     |   |   |   |
|-----|---|---|---|
| 本期末 | - | - | - |
|-----|---|---|---|

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                                 |
|-----------|------------------------------------|
|           | 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
| 活期存款利息收入  | 802,061.82                         |
| 定期存款利息收入  | 252,418,380.38                     |
| 其他存款利息收入  | 1,455,000.00                       |
| 结算备付金利息收入 | 3,558,799.74                       |
| 其他        | -                                  |
| 合计        | 258,234,241.94                     |

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期                                 |
|------------------|------------------------------------|
|                  | 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
| 债券投资收益——利息收入     | 321,779,132.25                     |
| 债券投资收益——买卖债券差价收入 | 6,792,588.36                       |
| 债券投资收益——赎回差价收入   | -                                  |
| 债券投资收益——申购差价收入   | -                                  |
| 合计               | 328,571,720.61                     |

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                                 |
|------------------------|------------------------------------|
|                        | 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 46,019,768,765.78                  |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 45,953,103,653.58                  |
| 减：应计利息总额               | 59,872,523.84                      |
| 减：交易费用                 | -                                  |

|          |              |
|----------|--------------|
| 买卖债券差价收入 | 6,792,588.36 |
|----------|--------------|

**6.4.7.14 资产支持证券投资收益**

**6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

**6.4.7.15 贵金属投资收益**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.16 衍生工具收益**

**6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

**6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

**6.4.7.17 股利收益**

注：本基金本报告期无股利收益。

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

注：本基金本报告期无公允价值变动收益。

**6.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |
|---------|-------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                             |
| 替代损益    | -                             |
| 其他      | 60,519.63                     |
| 合计      | 60,519.63                     |

**6.4.7.20 信用减值损失**

注：本基金本报告期无信用减值损失。

**6.4.7.21 其他费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |
|----|-------------------------------|
|----|-------------------------------|

|           |            |
|-----------|------------|
| 审计费用      | 44,630.98  |
| 信息披露费     | 59,507.37  |
| 证券出借违约金   | -          |
| 账户维护费     | 18,600.00  |
| 银行费用      | 60,854.20  |
| 指数使用费     | -          |
| 持有人大会-公证费 | -          |
| 持有人大会-律师费 | -          |
| 开户费       | -          |
| 上市费       | -          |
| 其他        | -          |
| 合计        | 183,592.55 |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                   | 与本基金的关系                 |
|-------------------------|-------------------------|
| 汇添富基金管理股份有限公司           | 基金管理人, 基金销售机构, 基金注册登记机构 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 (“浦发银行”) | 基金托管人, 基金代销机构           |
| 东方证券股份有限公司 (“东方证券”)     | 基金管理人的股东, 基金代销机构        |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |                  | 上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |                  |
|-------|---------------------------------------|------------------|--|------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期回购成交总额的比例 (%) | 成交金额                                       | 占当期回购成交总额的比例 (%) |
| 东方证券  | 523,929,699,000.00                    | 100.00           | 292,420,500,000.00                         | 100.00           |

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均不存在向关联方支付佣金的情况。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022 年 01 月 01 日至<br>2022 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 01 月 01 日至<br>2021 年 06 月 30 日 |
|-----------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 45,506,324.31                               | 26,118,648.66                                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 477,103.56                                  | 573,287.12                                       |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

R 为基金管理费年费率

基金管理费在基金合同生效后每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基

金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022 年 01 月 01 日至<br>2022 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 01 月 01 日至<br>2021 年 06 月 30 日 |
|----------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 15,168,774.74                               | 8,706,216.28                                     |

注：本基金的托管费按前一日的基金资产净值的 0.05% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

R 为基金托管费年费率

基金托管费在基金合同生效后每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |              |           |         |              | 合计           |
|----------------|---------------------------------------|--------------|-----------|---------|--------------|--------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                      |              |           |         |              |              |
|                | 汇添富货币 A                               | 汇添富货币 B      | 汇添富货币 C   | 汇添富货币 D | 汇添富货币 E      |              |
| 汇添富基金管理        | 52,773.47                             | 1,061,773.11 | 28,077.94 | -       | 1,771,480.95 | 2,914,105.47 |

|                |  |              |            |            |              |              |
|----------------|--|--------------|------------|------------|--------------|--------------|
| 股份有限公司         |  |              |            |            |              |              |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 12,944.59                                  | 4,623.78     | -          | 390,380.55 | -            | 407,948.92   |
| 东方证券股份有限公司     | 12,690.14                                  | 1,101.44     | 506,237.66 | 45.71      | -            | 520,074.95   |
| 合计             | 78,408.20                                  | 1,067,498.33 | 534,315.60 | 390,426.26 | 1,771,480.95 | 3,842,129.34 |
| 获得销售服务费的各关联方   | 上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |              |            |            |              |              |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |              |            |            |              |              |
|                | 汇添富货币 A                                    | 汇添富货币 B      | 汇添富货币 C    | 汇添富货币 D    | 汇添富货币 E      | 合计           |

| 名称             |           |              |              |            |   |              |
|----------------|-----------|--------------|--------------|------------|---|--------------|
| 汇添富基金管理股份有限公司  | 61,367.37 | 1,373,765.79 | 4,739.40     | -          | - | 1,439,872.56 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 15,048.50 | 2,562.12     | -            | 581,529.30 | - | 599,139.92   |
| 东方证券股份有限公司     | 9,450.22  | 1,615.49     | 4,331,276.85 | -          | - | 4,342,342.56 |
| 合计             | 85,866.09 | 1,377,943.40 | 4,336,016.25 | 581,529.30 | - | 6,381,355.04 |

注：本基金各级基金份额按照不同的费率计提销售服务费，但各级基金份额的销售服务费率

均不超过 0.25%年费率。

本基金 A 级基金份额的年销售服务费率为 0.25%/年。

本基金 B 级基金份额的年销售服务费率为 0.01%/年。

本基金 C 级基金份额的年销售服务费率为 0.25%/年。

本基金 D 级基金份额的年销售服务费率为 0.25%/年。

本基金 E 级基金份额的年销售服务费率为 0.01%/年。

各级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为各级基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日的该级基金份额的基金资产净值

R 为该级基金份额的销售服务费率

各级基金份额的销售服务费在基金合同生效后每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首 5 个工作日内从基金财产中一次性划往基金注册登记清算账户。由基金管理人支付给各销售机构，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：人民币元

| 本期<br>2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日      |                    |          |          |          |                    |               |
|---|--------------------|----------|----------|----------|--------------------|---------------|
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                            | 债券交易金额             |          | 基金逆回购    |          | 基金正回购              |               |
|   | 基金买<br>入           | 基金卖<br>出 | 交易金<br>额 | 利息收<br>入 | 交易金<br>额           | 利息支<br>出      |
| 上海浦东发展银行<br>股份有限公司                            | 181,763<br>,981.10 | -        | -        | -        | 401,800<br>,000.00 | 16,292.<br>16 |
| 上年度可比期间<br>2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |                    |          |          |          |                    |               |
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                            | 债券交易金额             |          | 基金逆回购    |          | 基金正回购              |               |
|   | 基金买<br>入           | 基金卖<br>出 | 交易金<br>额 | 利息收<br>入 | 交易金<br>额           | 利息支<br>出      |
| 上海浦东发展银行<br>股份有限公司                            | 129,256<br>,713.56 | -        | -        | -        | -                  | -             |

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 汇添富货币 A                                  |  |   |
|--|--|---|
| 项目                                       | 本期 2022 年 01 月 01 日至<br>2022 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 01 月<br>01 日至 2021 年 06 月 30 日 |
| 基金合同生效日<br>(2006 年 03 月 23<br>日) 持有的基金份额 | -  | -   |
| 报告期初持有的基金<br>份额                          | -  | -   |
| 报告期间申购/买入总<br>份额                         | -  | -   |
| 报告期间因拆分变动<br>份额                          | -  | -   |
| 减: 报告期间赎回/卖<br>出总份额                      | -  | -   |
| 报告期末持有的基金<br>份额                          | -  | -   |
| 报告期末持有的基金<br>份额占基金总份额比<br>例 (%)          | -  | -   |
| 汇添富货币 B                                  |  |   |
| 项目                                       | 本期 2022 年 01 月 01 日至<br>2022 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 01 月<br>01 日至 2021 年 06 月 30 日 |
| 基金合同生效日<br>(2006 年 03 月 23<br>日) 持有的基金份额 | -  | -   |
| 报告期初持有的基金<br>份额                          | 74,206,854.05                            | 72,365,311.32                                 |
| 报告期间申购/买入总<br>份额                         | 872,415.80                               | 954,715.15                                    |
| 报告期间因拆分变动<br>份额                          | -  | -   |
| 减: 报告期间赎回/卖<br>出总份额                      | -  | -   |
| 报告期末持有的基金<br>份额                          | 75,079,269.85                            | 73,320,026.47                                 |
| 报告期末持有的基金<br>份额占基金总份额比<br>例 (%)          | 0.35                                     | 0.22  |
| 汇添富货币 C                                  |  |   |
| 项目                                       | 本期 2022 年 01 月 01 日至<br>2022 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 01 月<br>01 日至 2021 年 06 月 30 日 |
| 基金合同生效日<br>(2006 年 03 月 23<br>日) 持有的基金份额 | -  | -   |

|   |  |   |
|---|--|---|
| 报告期初持有的基金份额                             | -  | -   |
| 报告期间申购/买入总份额                            | -  | -   |
| 报告期间因拆分变动份额                             | -  | -   |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                          | -  | -   |
| 报告期末持有的基金份额                             | -  | -   |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）                  | -  | -   |
| 汇添富货币 D                                 |  |   |
| 项目                                      | 本期 2022 年 01 月 01 日至<br>2022 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 01 月<br>01 日至 2021 年 06 月 30 日 |
| 基金合同生效日<br>（2006 年 03 月 23<br>日）持有的基金份额 | -  | -   |
| 报告期初持有的基金份额                             | -  | -   |
| 报告期间申购/买入总份额                            | -  | -   |
| 报告期间因拆分变动份额                             | -  | -   |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                          | -  | -   |
| 报告期末持有的基金份额                             | -  | -   |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）                  | -  | -   |
| 汇添富货币 E                                 |  |   |
| 项目                                      | 本期 2022 年 01 月 01 日至<br>2022 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 01 月<br>01 日至 2021 年 06 月 30 日 |
| 基金合同生效日<br>（2006 年 03 月 23<br>日）持有的基金份额 | -  | -   |
| 报告期初持有的基金份额                             | -  | -   |
| 报告期间申购/买入总份额                            | -  | -   |
| 报告期间因拆分变动份额                             | -  | -   |

|                        |   |   |
|------------------------|---|---|
| 减：报告期内赎回/卖出总份额         | - | - |
| 报告期末持有的基金份额            | - | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%） | - | - |

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 汇添富货币 A        |                      |                     |                       |                     |
|----------------|----------------------|---------------------|-----------------------|---------------------|
| 关联方名称          | 本期末 2022 年 06 月 30 日 |                     | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |                     |
|                | 持有的基金份额              | 持有的基金份额占基金总份额的比例（%） | 持有的基金份额               | 持有的基金份额占基金总份额的比例（%） |
|                | -                    | -                   | -                     | -                   |
| 汇添富货币 B        |                      |                     |                       |                     |
| 关联方名称          | 本期末 2022 年 06 月 30 日 |                     | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |                     |
|                | 持有的基金份额              | 持有的基金份额占基金总份额的比例（%） | 持有的基金份额               | 持有的基金份额占基金总份额的比例（%） |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 3,226,715,729.04     | 14.84               | 3,189,221,520.55      | 11.75               |
| 东方证券股份有限公司     | 51,080,196.39        | 0.23                | -                     | -                   |
| 汇添富货币 C        |                      |                     |                       |                     |
| 关联方名称          | 本期末 2022 年 06 月 30 日 |                     | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |                     |
|                | 持有的基金份额              | 持有的基金份额占基金总份额的比例（%） | 持有的基金份额               | 持有的基金份额占基金总份额的比例（%） |
|                | -                    | -                   | -                     | -                   |
| 汇添富货币 D        |                      |                     |                       |                     |
| 关联方            | 本期末 2022 年 06 月 30 日 |                     | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |                     |

| 名称             | 持有的基金份额              | 持有的基金份额占基金总份额的比例 (%) | 持有的基金份额               | 持有的基金份额占基金总份额的比例 (%) |
|----------------|----------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
|                | -                    | -                    | -                     | -                    |
| 汇添富货币 E        |                      |                      |                       |                      |
| 关联方名称          | 本期末 2022 年 06 月 30 日 |                      | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |                      |
|                | 持有的基金份额              | 持有的基金份额占基金总份额的比例 (%) | 持有的基金份额               | 持有的基金份额占基金总份额的比例 (%) |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 4,309,126,189.22     | 8.00                 | 300,000,000.00        | 1.32                 |

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |              | 上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |              |
|-------|---------------------------------------|--------------|--|--------------|
|       | 期末余额                                  | 当期利息收入       | 期末余额                                       | 当期利息收入       |
| 浦发银行  | 3,220,525,979.99                      | 5,082,672.73 | 612,799,862.85                             | 9,100,914.38 |

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 汇添富货币 A      |          |          |          |    |
|--------------|----------|----------|----------|----|
| 已按再投资形式转实收基金 | 直接通过应付赎回 | 应付利润本年变动 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|              |          |          |          |    |

|                  |                           |              |                |    |
|------------------|---------------------------|--------------|----------------|----|
|                  | 款转出金<br>额                 |              |                |    |
| 3,714,257.08     | -                         | -            | 3,714,257.08   |    |
| 汇添富货币 B          |                           |              |                |    |
| 已按再投资形式转实收<br>基金 | 直接通过<br>应付赎回<br>款转出金<br>额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合计       | 备注 |
| 271,837,466.75   | -                         | -            | 271,837,466.75 |    |
| 汇添富货币 C          |                           |              |                |    |
| 已按再投资形式转实收<br>基金 | 直接通过<br>应付赎回<br>款转出金<br>额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合计       | 备注 |
| 4,666,217.47     | -                         | -            | 4,666,217.47   |    |
| 汇添富货币 D          |                           |              |                |    |
| 已按再投资形式转实收<br>基金 | 直接通过<br>应付赎回<br>款转出金<br>额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合计       | 备注 |
| 3,154,806.13     | -                         | -            | 3,154,806.13   |    |
| 汇添富货币 E          |                           |              |                |    |
| 已按再投资形式转实收<br>基金 | 直接通过<br>应付赎回<br>款转出金<br>额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合计       | 备注 |
| 393,906,203.70   | -                         | -            | 393,906,203.70 |    |

#### 6.4.12 期末（2022 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 7,830,615,782.19 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名 | 回购到 | 期末估值 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|------|-----|-----|------|-------|--------|
|------|-----|-----|------|-------|--------|

|           | 称                    | 期日                     | 单价     |           |                |
|-----------|----------------------|------------------------|--------|-----------|----------------|
| 112106246 | 21 交通<br>银行<br>CD246 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.67  | 9,000,000 | 897,070,648.62 |
| 229904    | 22 贴现<br>国债 04       | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.81  | 400,000   | 39,923,421.16  |
| 2203673   | 22 进出<br>673         | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.87  | 500,000   | 49,936,963.74  |
| 229915    | 22 贴现<br>国债 15       | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.92  | 3,760,000 | 375,688,289.43 |
| 112110387 | 21 兴业<br>银行<br>CD387 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.63  | 1,000,000 | 99,632,118.20  |
| 229918    | 22 贴现<br>国债 18       | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.83  | 3,700,000 | 369,354,492.21 |
| 210306    | 21 进出<br>06          | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 101.83 | 1,300,000 | 132,383,984.60 |
| 2203675   | 22 进出<br>675         | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.79  | 1,000,000 | 99,786,649.04  |
| 227707    | 22 贴现<br>国开 07       | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.71  | 300,000   | 29,913,446.92  |
| 227708    | 22 贴现<br>国开 08       | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.69  | 1,000,000 | 99,687,021.77  |
| 2203676   | 22 进出<br>676         | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.77  | 2,500,000 | 249,415,064.12 |
| 112105214 | 21 建设<br>银行<br>CD214 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.16  | 1,000,000 | 99,156,221.56  |
| 190011    | 19 付息<br>国债 11       | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 102.59 | 4,500,000 | 461,637,559.40 |
| 112106240 | 21 交通<br>银行<br>CD240 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.73  | 2,851,000 | 284,332,293.44 |
| 112110328 | 21 兴业                | 2022 年                 | 99.80  | 87,000    | 8,682,405.02   |

|           |                      |                        |        |           |                |
|-----------|----------------------|------------------------|--------|-----------|----------------|
|           | 银行<br>CD328          | 07 月<br>01 日           |        |           |                |
| 112217054 | 22 光大<br>银行<br>CD054 | 2022 年<br>07 月<br>04 日 | 98.15  | 32,000    | 3,140,928.07   |
| 200312    | 20 进出<br>12          | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 102.76 | 3,000,000 | 308,288,984.34 |
| 112118202 | 21 华夏<br>银行<br>CD202 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.69  | 1,000,000 | 99,689,065.45  |
| 2203672   | 22 进出<br>672         | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.91  | 500,000   | 49,952,717.23  |
| 112206075 | 22 交通<br>银行<br>CD075 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 98.32  | 2,000,000 | 196,637,850.05 |
| 229922    | 22 贴现<br>国债 22       | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.78  | 600,000   | 59,865,510.35  |
| 210312    | 21 进出<br>12          | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 101.50 | 1,500,000 | 152,252,484.71 |
| 112104037 | 21 中国<br>银行<br>CD037 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.87  | 1,000,000 | 99,872,239.65  |
| 112106235 | 21 交通<br>银行<br>CD235 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.76  | 3,000,000 | 299,266,061.22 |
| 227705    | 22 贴现<br>国开 05       | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.93  | 500,000   | 49,966,556.56  |
| 112217017 | 22 光大<br>银行<br>CD017 | 2022 年<br>07 月<br>04 日 | 98.41  | 1,000,000 | 98,408,445.35  |
| 112105163 | 21 建设<br>银行<br>CD163 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.72  | 1,000,000 | 99,721,011.91  |
| 112105225 | 21 建设<br>银行<br>CD225 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.33  | 500,000   | 49,666,029.09  |
| 112215239 | 22 民生<br>银行<br>CD239 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.94  | 3,748,000 | 374,570,580.54 |

|           |                      |                        |        |           |                |
|-----------|----------------------|------------------------|--------|-----------|----------------|
| 229921    | 22 贴现<br>国债 21       | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.80  | 1,300,000 | 129,735,043.88 |
| 210407    | 21 农发<br>07          | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 101.91 | 3,100,000 | 315,920,840.04 |
| 112106286 | 21 交通<br>银行<br>CD286 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.24  | 5,000,000 | 496,220,430.49 |
| 112217054 | 22 光大<br>银行<br>CD054 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 98.15  | 1,800,000 | 176,677,204.18 |
| 210211    | 21 国开<br>11          | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 101.93 | 3,200,000 | 326,166,332.53 |
| 227706    | 22 贴现<br>国开 06       | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.83  | 200,000   | 19,966,812.84  |
| 112103146 | 21 农业<br>银行<br>CD146 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.08  | 692,000   | 68,561,423.65  |
| 2203674   | 22 进出<br>674         | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.81  | 2,750,000 | 274,477,804.35 |
| 112215256 | 22 民生<br>银行<br>CD256 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 97.74  | 2,221,000 | 217,091,376.20 |
| 112106221 | 21 交通<br>银行<br>CD221 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.83  | 1,000,000 | 99,827,069.89  |
| 112118299 | 21 华夏<br>银行<br>CD299 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.18  | 1,000,000 | 99,183,582.99  |
| 112104044 | 21 中国<br>银行<br>CD044 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.74  | 1,500,000 | 149,616,992.27 |
| 210010    | 21 付息<br>国债 10       | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 101.90 | 4,400,000 | 448,376,450.36 |
| 220201    | 22 国开<br>01          | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 100.86 | 1,000,000 | 100,856,896.71 |
| 112217086 | 22 光大<br>银行          | 2022 年<br>07 月         | 98.25  | 90,000    | 8,842,588.49   |

|           |                      |                        |       |            |                  |
|-----------|----------------------|------------------------|-------|------------|------------------|
|           | CD086                | 04 日                   |       |            |                  |
| 2203671   | 22 进出<br>671         | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.93 | 400,000    | 39,973,256.42    |
| 112105136 | 21 建设<br>银行<br>CD136 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.91 | 500,000    | 49,957,139.77    |
| 112107117 | 21 招商<br>银行<br>CD117 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.16 | 1,000,000  | 99,156,221.56    |
| 112107097 | 21 招商<br>银行<br>CD097 | 2022 年<br>07 月<br>01 日 | 99.76 | 1,000,000  | 99,756,369.08    |
| 合计        |                      |                        |       | 84,431,000 | 8,458,262,879.45 |

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2022 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 3,481,689,067.31        | 2,442,067,985.23         |
| 合计     | 3,481,689,067.31        | 2,442,067,985.23         |

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、超短期融资券、中央票据。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2022 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 29,655,338,363.66       | 18,824,622,098.52        |
| 合计     | 29,655,338,363.66       | 18,824,622,098.52        |

注：本表列示期限在一年以内的同业存单。短期信用评级 A-1 所填列的为主体评级 AAA 的同业存单，短期信用评级 A-1 以下所填列的为主体评级 AAA 以下的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2022 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | -                       | -                        |
| AAA 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 922,179,028.45          | 240,095,821.11           |
| 合计     | 922,179,028.45          | 240,095,821.11           |

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、中央票据。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

|   |        |        |          |                  |                  |     |    |
|---|--------|--------|----------|------------------|------------------|-----|----|
| 本<br>期<br>末<br>20<br>22<br>年<br>06<br>月<br>30 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1<br>-<br>5<br>年 | 5<br>年<br>以<br>上 | 不计息 | 合计 |
|---|--------|--------|----------|------------------|------------------|-----|----|

| 日        |                   |                   |                   |   |   |                  |                   |
|----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|---|------------------|-------------------|
| 资产       |                   |                   |                   |   |   |                  |                   |
| 银行存款     | 6,610,575,585.86  | 5,240,783,773.03  | 12,891,781,612.12 | - | - | -                | 24,743,140,971.01 |
| 结算备付金    | 488,832,533.59    | -                 | -                 | - | - | -                | 488,832,533.59    |
| 存出保证金    | -                 | -                 | -                 | - | - | -                | -                 |
| 交易性金融资产  | 2,764,026,081.31  | 18,088,771,302.19 | 13,206,409,075.92 | - | - | -                | 34,059,206,459.42 |
| 衍生金融资产   | -                 | -                 | -                 | - | - | -                | -                 |
| 买入返售金融资产 | 24,915,945,426.07 | -                 | -                 | - | - | -                | 24,915,945,426.07 |
| 债权投资     | -                 | -                 | -                 | - | - | -                | -                 |
| 应收       | -                 | -                 | -                 | - | - | 1,148,986,898.68 | 1,148,986,898.68  |

|         |                   |                   |                   |   |   |                  |                   |
|---------|-------------------|-------------------|-------------------|---|---|------------------|-------------------|
| 清算款     |                   |                   |                   |   |   |                  |                   |
| 应收股利    | -                 | -                 | -                 | - | - | -                | -                 |
| 应收申购款   | -                 | -                 | -                 | - | - | 35,331,519.16    | 35,331,519.16     |
| 递延所得税资产 | -                 | -                 | -                 | - | - | -                | -                 |
| 其他资产    | -                 | -                 | -                 | - | - | -                | -                 |
| 资产总计    | 34,779,379,626.83 | 23,329,555,075.22 | 26,098,190,688.04 | - | - | 1,184,318,417.84 | 85,391,443,807.93 |
| 负债      |                   |                   |                   |   |   |                  |                   |
| 短期借款    | -                 | -                 | -                 | - | - | -                | -                 |
| 交易性金融负债 | -                 | -                 | -                 | - | - | -                | -                 |
| 衍生金融    | -                 | -                 | -                 | - | - | -                | -                 |

|           |                  |   |   |   |   |                |                  |
|-----------|------------------|---|---|---|---|----------------|------------------|
| 负债        |                  |   |   |   |   |                |                  |
| 卖出回购金融资产款 | 7,830,615,782.19 | - | - | - | - | -              | 7,830,615,782.19 |
| 应付清算款     | -                | - | - | - | - | 808,850,483.72 | 808,850,483.72   |
| 应付赎回款     | -                | - | - | - | - | 170,143.41     | 170,143.41       |
| 应付管理人报酬   | -                | - | - | - | - | 9,766,445.42   | 9,766,445.42     |
| 应付托管费     | -                | - | - | - | - | 3,255,481.78   | 3,255,481.78     |
| 应付销售服务费   | -                | - | - | - | - | 874,645.09     | 874,645.09       |
| 应付投资      | -                | - | - | - | - | -              | -                |

|                       |                   |                   |                   |       |       |                |                   |
|-----------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------|-------|----------------|-------------------|
| 顾问费                   |                   |                   |                   |       |       |                |                   |
| 应交税费                  | -                 | -                 | -                 | -     | -     | 1,468,611.99   | 1,468,611.99      |
| 应付利润                  | -                 | -                 | -                 | -     | -     | -              | -                 |
| 递延所得税负债               | -                 | -                 | -                 | -     | -     | -              | -                 |
| 其他负债                  | -                 | -                 | -                 | -     | -     | 397,794.90     | 397,794.90        |
| 负债总计                  | 7,830,615,782.19  | -                 | -                 | -     | -     | 824,783,606.31 | 8,655,399,388.50  |
| 利率敏感度缺口               | 26,948,763,844.64 | 23,329,555,075.22 | 26,098,190,688.04 | -     | -     | 359,534,811.53 | 76,736,044,419.43 |
| 上年度末 2021 年 12 月 31 日 | 1 个月以内            | 1-3 个月            | 3 个月-1 年          | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计                |

|          |                   |                  |                   |   |   |              |                   |
|----------|-------------------|------------------|-------------------|---|---|--------------|-------------------|
| 资产       |                   |                  |                   |   |   |              |                   |
| 银行存款     | 4,012,569,906.28  | 7,868,000,000.00 | 7,880,000,000.00  | - | - | -            | 19,760,569,906.28 |
| 结算备付金    | 572,655,000.00    | -                | -                 | - | - | -            | 572,655,000.00    |
| 存出保证金    | -                 | -                | -                 | - | - | -            | -                 |
| 交易性金融资产  | 2,782,531,664.08  | 8,160,881,752.61 | 10,563,372,488.17 | - | - | -            | 21,506,785,904.86 |
| 衍生金融资产   | -                 | -                | -                 | - | - | -            | -                 |
| 买入返售金融资产 | 11,860,000,000.00 | -                | -                 | - | - | -            | 11,860,000,000.00 |
| 债权投资     | -                 | -                | -                 | - | - | -            | -                 |
| 应收清      | -                 | -                | -                 | - | - | 1,711,780.86 | 1,711,780.86      |

|         |                   |                   |                   |   |   |                |                   |
|---------|-------------------|-------------------|-------------------|---|---|----------------|-------------------|
| 算款      |                   |                   |                   |   |   |                |                   |
| 应收股利    | -                 | -                 | -                 | - | - | -              | -                 |
| 应收申购款   | -                 | -                 | -                 | - | - | 380,242.08     | 380,242.08        |
| 递延所得税资产 | -                 | -                 | -                 | - | - | -              | -                 |
| 其他资产    | -                 | -                 | -                 | - | - | 142,697,870.27 | 142,697,870.27    |
| 资产总计    | 19,227,756,570.36 | 16,028,881,752.61 | 18,443,372,488.17 | - | - | 144,789,893.21 | 53,844,800,704.35 |
| 负债      |                   |                   |                   |   |   |                |                   |
| 短期借款    | -                 | -                 | -                 | - | - | -              | -                 |
| 交易性金融负债 | -                 | -                 | -                 | - | - | -              | -                 |
| 衍生金融负债  | -                 | -                 | -                 | - | - | -              | -                 |

|           |                  |   |   |   |   |              |                  |
|-----------|------------------|---|---|---|---|--------------|------------------|
| 债         |                  |   |   |   |   |              |                  |
| 卖出回购金融资产款 | 2,289,946,055.07 | - | - | - | - | -            | 2,289,946,055.07 |
| 应付清算款     | -                | - | - | - | - | -            | -                |
| 应付赎回款     | -                | - | - | - | - | -            | -                |
| 应付管理人报酬   | -                | - | - | - | - | 6,238,638.83 | 6,238,638.83     |
| 应付托管费     | -                | - | - | - | - | 2,079,546.26 | 2,079,546.26     |
| 应付销售服务费   | -                | - | - | - | - | 689,794.27   | 689,794.27       |
| 应付投资顾问    | -                | - | - | - | - | -            | -                |

|         |                   |                   |                   |   |   |                |                   |
|---------|-------------------|-------------------|-------------------|---|---|----------------|-------------------|
| 问费      |                   |                   |                   |   |   |                |                   |
| 应交税费    | -                 | -                 | -                 | - | - | 1,462,671.04   | 1,462,671.04      |
| 应付利润    | -                 | -                 | -                 | - | - | -              | -                 |
| 递延所得税负债 | -                 | -                 | -                 | - | - | -              | -                 |
| 其他负债    | -                 | -                 | -                 | - | - | 690,485.07     | 690,485.07        |
| 负债总计    | 2,289,946,055.07  | -                 | -                 | - | - | 11,161,135.47  | 2,301,107,190.54  |
| 利率敏感度缺口 | 16,937,810,515.29 | 16,028,881,752.61 | 18,443,372,488.17 | - | - | 133,628,757.74 | 51,543,693,513.81 |

上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |   |
|----|---|
| 假设 | 1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；                       |
|    | 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； |
|    | 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；                |

|    |  |                             |                       |
|----|--|-----------------------------|-----------------------|
|    | 4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； |                             |                       |
|    | 5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。  |                             |                       |
| 分析 | 相关风险变量的变动  | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                       |
|    |  | 本期末 2022 年 06 月 30 日        | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|    | 基准利率减少 25 个基点  | 27,767,275.01               | 16,705,518.36         |
|    | 基准利率增加 25 个基点  | -27,694,811.27              | -16,668,201.30        |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种和证券交易所的债券回购产品，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大市场价格风险。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

|               |                         |
|---------------|-------------------------|
| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022 年 06 月 30 日 |
|---------------|-------------------------|

|      |                   |
|------|-------------------|
| 第一层次 | -                 |
| 第二层次 | 34,059,206,459.42 |
| 第三层次 | -                 |
| 合计   | 34,059,206,459.42 |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额                | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|-------------------|---------------|
| 1  | 固定收益投资            | 34,059,206,459.42 | 39.89         |
|    | 其中：债券             | 34,059,206,459.42 | 39.89         |
|    | 资产支持证券            | -                 | -             |
| 2  | 买入返售金融资产          | 24,915,945,426.07 | 29.18         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                 | -             |
| 3  | 银行存款和结算备付金合计      | 25,231,973,504.60 | 29.55         |
| 4  | 其他各项资产            | 1,184,318,417.84  | 1.39          |

|   |    |                   |        |
|---|----|-------------------|--------|
| 5 | 合计 | 85,391,443,807.93 | 100.00 |
|---|----|-------------------|--------|

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值的比例（%）    |               |
|----|--------------|------------------|---------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 2.62             |               |
|    | 其中：买断式回购融资   | -                |               |
| 序号 | 项目           | 金额               | 占基金资产净值的比例（%） |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | 7,830,615,782.19 | 10.20         |
|    | 其中：买断式回购融资   | -                | -             |

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

注：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目                | 天数 |
|-------------------|----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 86 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 89 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 56 |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限                 | 各期限资产占基金资产净值的比例（%） | 各期限负债占基金资产净值的比例（%） |
|----|------------------------|--------------------|--------------------|
| 1  | 30 天以内                 | 45.15              | 11.26              |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 11.52              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 17.91              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 4  | 90 天（含）—120 天          | 5.66               | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |

|    |                        |        |       |
|----|------------------------|--------|-------|
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）      | 30.77  | -     |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -      | -     |
| 合计 |                        | 111.00 | 11.26 |

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种                 | 按实际利率计算的账面金额      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------------------|-------------------|--------------|
| 1  | 国家债券                 | 1,884,580,766.79  | 2.46         |
| 2  | 央行票据                 | -                 | -            |
| 3  | 金融债券                 | 2,298,945,815.92  | 3.00         |
|    | 其中：政策性金融债            | 2,298,945,815.92  | 3.00         |
| 4  | 企业债券                 | -                 | -            |
| 5  | 企业短期融资券              | 220,341,513.05    | 0.29         |
| 6  | 中期票据                 | -                 | -            |
| 7  | 同业存单                 | 29,655,338,363.66 | 38.65        |
| 8  | 地方政府债                | -                 | -            |
| 9  | 其他                   | -                 | -            |
| 10 | 合计                   | 34,059,206,459.42 | 44.38        |
| 11 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -                 | -            |

#### 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称              | 债券数量（张）   | 按实际利率计算的账面价值   | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-------------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 112106246 | 21 交通银行 CD246     | 9,000,000 | 897,070,648.62 | 1.17         |
| 2  | 112281612 | 22 广州农村商业银行 CD076 | 8,000,000 | 796,694,976.12 | 1.04         |
| 3  | 112213086 | 22 浙商银行 CD086     | 8,000,000 | 792,482,048.52 | 1.03         |

|    |           |                  |           |                |      |
|----|-----------|------------------|-----------|----------------|------|
| 4  | 112213023 | 22 浙商银行 CD023    | 7,000,000 | 698,589,983.09 | 0.91 |
| 5  | 112215239 | 22 民生银行 CD239    | 6,000,000 | 599,632,732.99 | 0.78 |
| 6  | 112186433 | 21 宁波银行 CD217    | 5,000,000 | 499,005,641.43 | 0.65 |
| 7  | 112280208 | 22 广东顺德农商行 CD067 | 5,000,000 | 498,485,406.39 | 0.65 |
| 8  | 112280539 | 22 苏州银行 CD159    | 5,000,000 | 498,247,711.28 | 0.65 |
| 9  | 112189231 | 21 重庆农村商行 CD228  | 5,000,000 | 498,078,525.48 | 0.65 |
| 10 | 112280911 | 22 东莞银行 CD178    | 5,000,000 | 498,032,024.38 | 0.65 |

### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

| 项目                            | 偏离情况     |
|-------------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数 | -        |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.0460%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0033% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0229%  |

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.50%情况说明

注：本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.50%的情况。

### 7.8 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产

#### 支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1

本基金估值采用摊余成本法计价，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销。

#### 7.9.2

本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司、广州农村商业银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、

广东顺德农村商业银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、重庆农村商业银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额               |
|----|-------|------------------|
| 1  | 存出保证金 | -                |
| 2  | 应收清算款 | 1,148,986,898.68 |
| 3  | 应收利息  | -                |
| 4  | 应收申购款 | 35,331,519.16    |
| 5  | 其他应收款 | -                |
| 6  | 待摊费用  | -                |
| 7  | 其他    | -                |
| 8  | 合计    | 1,184,318,417.84 |

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别    | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额      | 持有人结构             |           |                |           |
|---------|----------|----------------|-------------------|-----------|----------------|-----------|
|         |          |                | 机构投资者             |           | 个人投资者          |           |
|         |          |                | 持有份额              | 占总份额比例(%) | 持有份额           | 占总份额比例(%) |
| 汇添富货币 A | 26,762   | 13,556.77      | 97,196,461.98     | 26.79     | 265,609,783.77 | 73.21     |
| 汇添富货币   | 137      | 158,699,566.60 | 21,643,511,231.65 | 99.55     | 98,329,393.10  | 0.45      |

|         |         |            |                   |       |                  |        |
|---------|---------|------------|-------------------|-------|------------------|--------|
| B       |         |            |                   |       |                  |        |
| 汇添富货币 C | 135,171 | 3,480.31   | 11,583,419.68     | 2.46  | 458,854,172.46   | 97.54  |
| 汇添富货币 D | 571,243 | 514.79     | 1.55              | 0.00  | 294,068,397.30   | 100.00 |
| 汇添富货币 E | 68,535  | 785,976.39 | 45,833,165,652.10 | 85.09 | 8,033,725,905.84 | 14.91  |
| 合计      | 801,848 | 95,698.99  | 67,585,456,766.96 | 88.08 | 9,150,587,652.47 | 11.92  |

### 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额（份）          | 占总份额比例（%） |
|----|-------|------------------|-----------|
| 1  | 银行类机构 | 7,535,841,918.26 | 9.82      |
| 2  | 银行类机构 | 5,569,585,842.59 | 7.26      |
| 3  | 银行类机构 | 4,004,538,828.67 | 5.22      |
| 4  | 银行类机构 | 3,641,217,857.27 | 4.75      |
| 5  | 银行类机构 | 2,947,077,119.27 | 3.84      |
| 6  | 银行类机构 | 2,552,486,361.66 | 3.33      |
| 7  | 银行类机构 | 2,496,529,826.07 | 3.25      |
| 8  | 银行类机构 | 2,375,181,304.52 | 3.10      |
| 9  | 其他机构  | 2,107,648,879.71 | 2.75      |
| 10 | 银行类机构 | 2,042,416,621.22 | 2.66      |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                 | 份额级别    | 持有份额总数（份）    | 占基金总份额比例（%） |
|--------------------|---------|--------------|-------------|
| 基金管理人所有<br>从业人员持有本 | 汇添富货币 A | 8,071.58     | 0.00        |
|                    | 汇添富货币 B | 6,466,113.39 | 0.03        |

|    |         |                |      |
|----|---------|----------------|------|
| 基金 | 汇添富货币 C | 74,748.97      | 0.02 |
|    | 汇添富货币 D | 1.05           | 0.00 |
|    | 汇添富货币 E | 122,467,224.96 | 0.23 |
|    | 合计      | 129,016,159.95 | 0.17 |

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别    | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|---------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 汇添富货币 A | 0                 |
|                                | 汇添富货币 B | 0                 |
|                                | 汇添富货币 C | 0                 |
|                                | 汇添富货币 D | 0                 |
|                                | 汇添富货币 E | >100              |
|                                | 合计      | >100              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 汇添富货币 A | 0                 |
|                                | 汇添富货币 B | 0                 |
|                                | 汇添富货币 C | 0                 |
|                                | 汇添富货币 D | 0                 |
|                                | 汇添富货币 E | 0~10              |
|                                | 合计      | 0~10              |

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                         | 汇添富货币 A          | 汇添富货币 B           | 汇添富货币 C        | 汇添富货币 D        | 汇添富货币 E           |
|----------------------------|------------------|-------------------|----------------|----------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2006年03月23日）基金份额总额 | 4,104,914,022.13 | -                 | -              | -              | -                 |
| 本报告期初                      | 739,946,875.63   | 27,142,224,562.44 | 572,098,262.59 | 324,596,112.29 | 22,764,827,700.86 |

|   |                    |                       |                    |                    |                       |
|---|--------------------|-----------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|
| 基金<br>份额<br>总额  |                    |                       |                    |                    |                       |
| 本<br>报<br>告<br>期<br>基<br>金<br>总<br>申<br>购<br>份<br>额       | 409,201,354.<br>50 | 11,454,312,36<br>1.84 | 755,580,406<br>.78 | 47,122,199.<br>71  | 66,311,308,62<br>8.62 |
| 减：<br>本<br>报<br>告<br>期<br>基<br>金<br>总<br>赎<br>回<br>份<br>额 | 786,341,984.<br>38 | 16,854,696,29<br>9.53 | 857,241,077<br>.23 | 77,649,913.<br>15  | 35,209,244,77<br>1.54 |
| 本<br>报<br>告<br>期<br>基<br>金<br>拆<br>分<br>变<br>动<br>份<br>额  | -                  | -                     | -                  | -                  | -                     |
| 本<br>报<br>告<br>期<br>期<br>末<br>基<br>金<br>份<br>额<br>总<br>额  | 362,806,245.<br>75 | 21,741,840,62<br>4.75 | 470,437,592<br>.14 | 294,068,398<br>.85 | 53,866,891,55<br>7.94 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内未发生涉及公募基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易 |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|--------|--------|------|------------------|-----------|----------------|----|
|        |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 东方证券   | 3      | -    | -                | -         | -              |    |
| 东北证券   | 2      | -    | -                | -         | -              |    |
| 申万宏源证券 | 2      | -    | -                | -         | -              |    |
| 浙商证券   | 1      | -    | -                | -         | -              |    |
| 中信建投证券 | 1      | -    | -                | -         | -              |    |
| 中信证券   | 3      | -    | -                | -         | -              |    |

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 债券交易 |                  | 债券回购交易             |                    | 权证交易 |                  | 基金交易 |                  |
|--------|------|------------------|--------------------|--------------------|------|------------------|------|------------------|
|        | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额               | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 (%) |
| 东方证券   | -    | -                | 523,929,699,000.00 | 100.00             | -    | -                | -    | -                |
| 东北证券   | -    | -                | -                  | -                  | -    | -                | -    | -                |
| 申万宏源证券 | -    | -                | -                  | -                  | -    | -                | -    | -                |
| 浙商证券   | -    | -                | -                  | -                  | -    | -                | -    | -                |
| 中信建投证券 | -    | -                | -                  | -                  | -    | -                | -    | -                |
| 中信证券   | -    | -                | -                  | -                  | -    | -                | -    | -                |

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分

配比例。

(3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定,投资总监审批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用,基金会计应负责协助及时催缴。

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定,同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内新增 1 家证券公司的 1 个交易单元:中信建投证券(新三板单元)。

## 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注:本基金本报告期未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

## 10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式                         | 法定披露日期           |
|----|--|--------------------------------|------------------|
| 1  | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告          | 上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站 | 2022 年 01 月 01 日 |
| 2  | 关于汇添富货币市场基金 A 类份额和 B 类份额暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告      | 上交所,证券时报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站    | 2022 年 01 月 05 日 |
| 3  | 关于汇添富货币市场基金 2022 年春节假期前暂停 A 类、B 类份额申购(含定投及转换转入)业务的公告 | 上交所,证券时报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站    | 2022 年 01 月 24 日 |
| 4  | 汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告                     | 上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证           | 2022 年 01 月 24 日 |

|    |   |                                    |                  |
|----|---|------------------------------------|------------------|
|    |   | 监会基金电子披露网站                         |                  |
| 5  | 关于汇添富货币市场基金 A 类份额和 B 类份额恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告         | 上交所, 证券时报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站     | 2022 年 03 月 23 日 |
| 6  | 关于汇添富货币市场基金 A 类份额和 B 类份额暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告         | 上交所, 证券时报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站     | 2022 年 03 月 28 日 |
| 7  | 汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年年度报告                            | 上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022 年 03 月 31 日 |
| 8  | 关于汇添富货币市场基金 E 类份额暂停大额申购、转换转入业务的公告                       | 上交所, 证券时报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站     | 2022 年 04 月 12 日 |
| 9  | 汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要                     | 上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站      | 2022 年 04 月 21 日 |
| 10 | 汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第一季度报告                          | 上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站 | 2022 年 04 月 22 日 |
| 11 | 关于汇添富货币市场基金 2022 年劳动节假期前暂停 A 类、B 类份额申购 (含定投及转换转入) 业务的公告 | 上交所, 证券时报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站     | 2022 年 04 月 25 日 |
| 12 | 汇添富基金管理股份有限公司关于在直销中心开通旗下部分基金跨 TA 转换业务的公告                | 上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站      | 2022 年 04 月 28 日 |
| 13 | 关于汇添富货币市场基金 B 类份额和 E 类份额恢复大额申购、转换转入业务的公告                | 上交所, 证券时报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站     | 2022 年 05 月 19 日 |
| 14 | 关于汇添富货币市场基金 2022 年端午节假期前暂停 A 类、B 类份额申购 (含定投及转换转入) 业务的公告 | 上交所, 证券时报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站     | 2022 年 05 月 27 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富货币市场基金募集的文件；
- 2、《汇添富货币市场基金基金合同》；
- 3、《汇添富货币市场基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富货币市场基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

### 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2022 年 08 月 31 日